



O Carlton James Diversified Alpha Fund (DAF) é um fundo mútuo projetado para clientes que buscam proteger seu capital da volatilidade do mercado. O DAF consegue isso por meio da diversificação em investimentos não correlacionados com os mercados financeiros, como dívida, capital privado ou financiamento comercial. Isso permite que o fundo tenha retornos consistentes independentemente das condições econômicas.

OBJETIVOS DO FUNDO

- Proteger o capital do investidor contra a volatilidade do mercado
- Preparar investimentos para todas as fases do ciclo econômico
- Produzir retornos trimestrais consistentes
- Atingir rendimento líquido de 8% ao ano

DESTAQUES DO FUNDO

- Retorno mensal: **-0,02%**
- Dividendo declarado: **+ 2,50%**
- YTD: **+11,46%**
- 12 mese: **+18,71%**
- 2020: **+14,88%**

PLATAFORMAS

- Hansard International
- Custodian Life
- Capital International Group
- Gravitas
- Trireme
- The Investment Platform
- Psagot
- Dentons
- Ortega
- OMI S.A
- Universal Investment Platform
- Meitav Dash
- Utmost
- Quilter

CONTATO

ROBSON OLIVEIRA

Head of Latin American Sales

M: +44 7440 020021

T: +44 1793858275

E-mail: robson@carltonjamesgroup.com



ESTRUTURA

Companhia:	Navigator Global Fund Manager Platform SPC
Portfólio segregado:	Carlton James Diversified Alpha Fund
Gerente de investimentos:	Mollitium Investment Management Ltd
Domicílio:	Cayman Islands
Consultor de investimentos:	Diversified Global Investment Advisors Ltd
Estrutura:	Fundo regulamentado não listado
ISIN:	KYG6401N2454
Taxa de desempenho:	30% over a hurdle of 9% per annum
Hurdle:	9%
Liquidez:	Liquidez mensal com aviso prévio de 10 dias
Share Class:	USD 1 Share Class

PREPARAÇÃO E PLANEJAMENTO

O desempenho de maio foi de -0,02%, trazendo o acumulado deste ano do fundo para + 11,46%, incluindo dividendos. O retorno médio mensal desde o princípio do fundo agora está em + 0,66% por mês. O Sharpe Ratio é de 0,74 (com referência ao US Treasury Bond 5 anos em 31 de maio de 2021).

O desempenho de maio está em linha com a estratégia trimestral implementada pelo comitê de investimentos. Esse é um movimento estratégico que visa garantir o crescimento sustentável, protegendo o interesse de nossos investidores no médio e longo prazo.

Os retornos da estratégia Alpha do fundo são alcançados através de melhorias nas empresas em que o fundo investe, sem o risco de grande volatilidade inferior durante o período de desempenho. O fundo implementa melhorias em todos seus investimentos, incluindo conversibilidade; participação nos lucros; equity; e mais. O desempenho é calculado por trimestre. O amadurecimento do fundo significa que a estratégia desenvolvida pela gestão do mesmo está funcionando conforme o planejado.

A DAF atingiu todos os 4 objetivos do fundo: protegendo o capital do investidor contra a volatilidade do mercado; preparar com sucesso investimentos para todas as fases do ciclo econômico; produzir retornos trimestrais consistentes; e rendimento líquido superior a 8% ao ano. O fundo está agora preparado para a próxima fase do ciclo econômico, que se prevê ser uma recessão global dupla.

DESTAQUES DE DESEMPENHO

Desvio padrão	0,02
Índice Sharpe	0,74
Beta	0,05
Retorno médio mensal	
DAF	+0,66%
Treasury Yield 5 Years	-1,05%

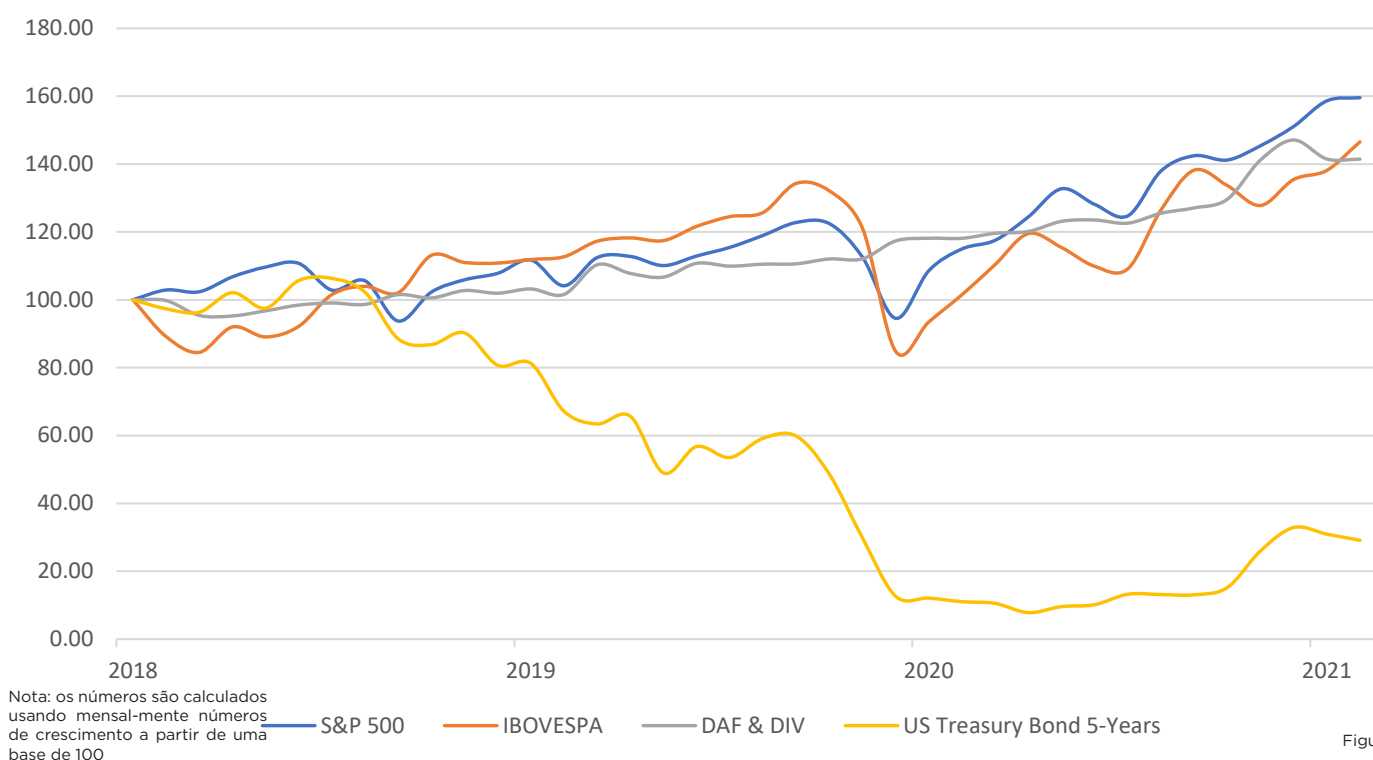
Benchmark de cálculo: Beta (S&P 500), Índice Sharpe (Treasury Yield 5 Years).

PERFORMANCE MENSAL DO VPL

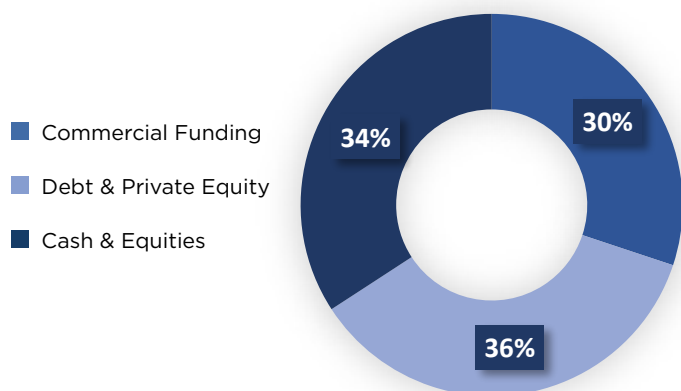
	2019	2020	2021
Janeiro	-0,95%* DIV	+0,25%	+2,01%
Fevereiro	+2,16%	+0,03%	+8,91%
Março	-0,77%	+3,71%* DIV	+1,68%* DIV
Abril	+1,23%	+0,67%	-1,37%
Maio	-1,57%	-0,02%	-0,02%
Junho	+8,59%	+0,75%* DIV	
Julho	-2,30%	+0,45%	
Agosto	-1,01%	+2,48%	
Setembro	+0,85%	-0,17%* DIV	
Outubro	-0,75%* DIV	-0,76%	
Novembro	+0,52%	+2,39%	
Dezembro	+0,09%* DIV	+1,24%	

*Dividendo declarado

DAF EM COMPARAÇÃO COM S&P 500, FTSE 100 E US 5Y TREASURY BONDS



MAIO ALOCAÇÃO DE ATIVOS



CLASSE 1 DE AÇÕES EM USD

Maio 31 2021 compartilhar preço: \$1264,81 USD

Período	Maio 2021	Year to Date	1 Year
Desempenho %	-0,02%	+11,46%	+18,71%

ACUMULAÇÃO - CLASSE 2 DE AÇÕES EM USD

Maio 31 2021 compartilhar preço: \$4998.86 USD

Período	Maio 2021	Year to Date	1 Year
Desempenho %	-0.02%	-0.02%	-0.02%